

宝盈货币市场证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
交易代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 5 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,408,700,717.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈货币 A	宝盈货币 B
下属分级基金的交易代码:	213009	213909
报告期末下属分级基金的份额总额	3,121,511,397.92 份	14,287,189,319.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。 投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征，把风险控制预算之内，在不增加风险的基础上保持高流动性，最终追求稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。 本基金定位于现金管理的工具，采用活期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准，更能体现本基金良好的流动性与安全性。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2016 年		2015 年		2014 年	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
本期已实现 收益	93,363,887.32	652,507,368.55	151,185,549.40	700,035,566.19	77,581,801.76	487,570,816.33
本期利润	93,363,887.32	652,507,368.55	151,185,549.40	700,035,566.19	77,581,801.76	487,570,816.33
本期净值收 益率	2.5975%	2.8442%	3.7074%	3.9568%	5.1699%	5.4223%
3.1.2 期末 数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期末基金资 产净值	3,121,511,397.9 2	14,287,189,319.34	3,559,341,762.13	24,737,727,017.32	3,245,468,617.83	5,593,364,284.62
期末基金份 额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，本基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

4、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④

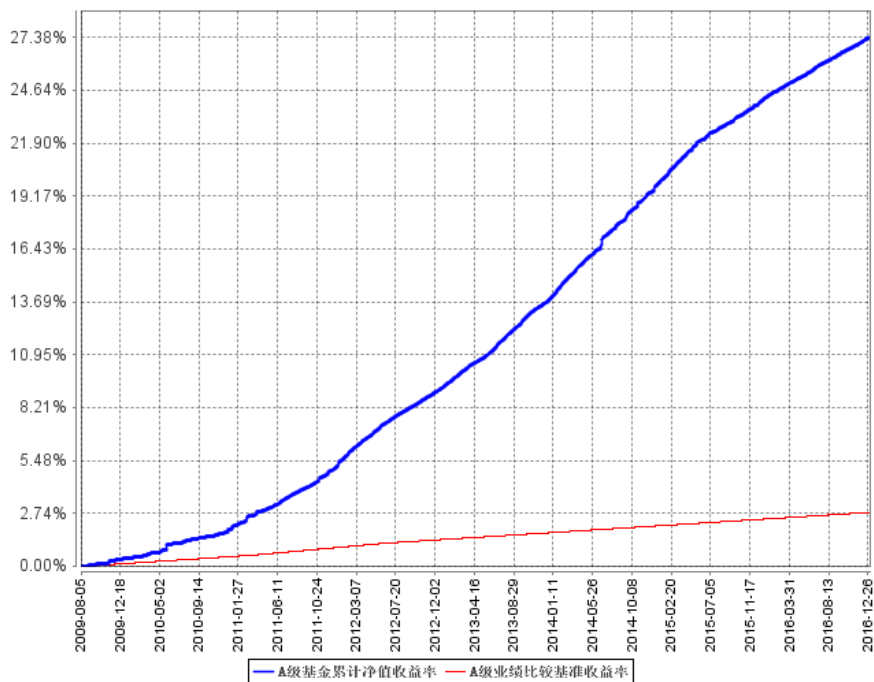
过去三个月	0.5979%	0.0033%	0.0882%	0.0000%	0.5097%	0.0033%
过去六个月	1.2211%	0.0038%	0.1764%	0.0000%	1.0447%	0.0038%
过去一年	2.5975%	0.0043%	0.3510%	0.0000%	2.2465%	0.0043%
过去三年	11.9021%	0.0103%	1.0510%	0.0000%	10.8511%	0.0103%
过去五年	21.1298%	0.0090%	1.8211%	0.0001%	19.3087%	0.0089%
自基金合同 生效起至今	27.3830%	0.0114%	2.7978%	0.0001%	24.5852%	0.0113%

宝盈货币 B

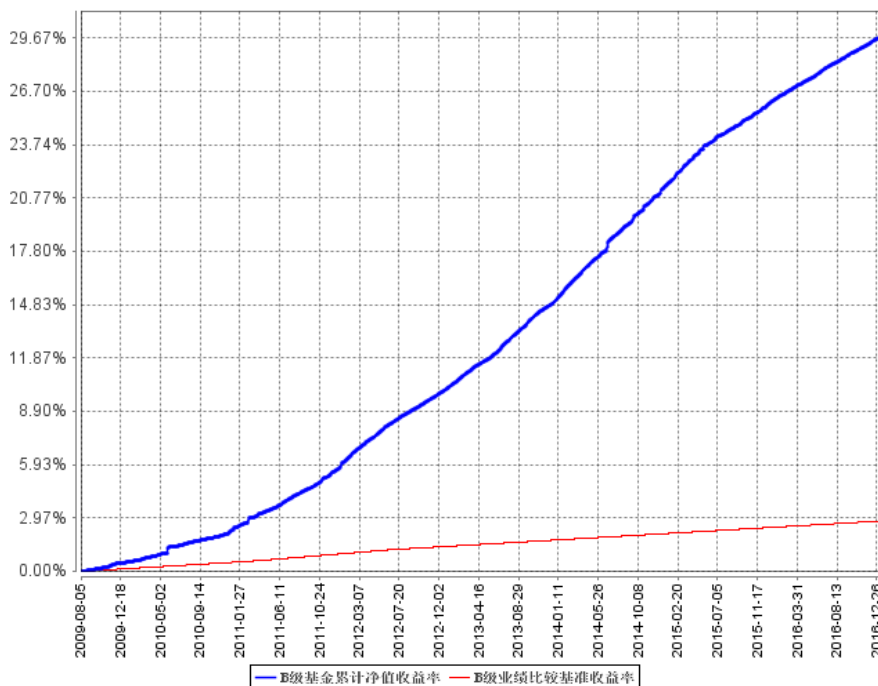
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6587%	0.0033%	0.0882%	0.0000%	0.5705%	0.0033%
过去六个月	1.3436%	0.0038%	0.1764%	0.0000%	1.1672%	0.0038%
过去一年	2.8442%	0.0043%	0.3510%	0.0000%	2.4932%	0.0043%
过去三年	12.7107%	0.0103%	1.0510%	0.0000%	11.6597%	0.0103%
过去五年	22.5908%	0.0090%	1.8211%	0.0001%	20.7697%	0.0089%
自基金合同 生效起至今	29.6695%	0.0114%	2.7978%	0.0001%	26.8717%	0.0113%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



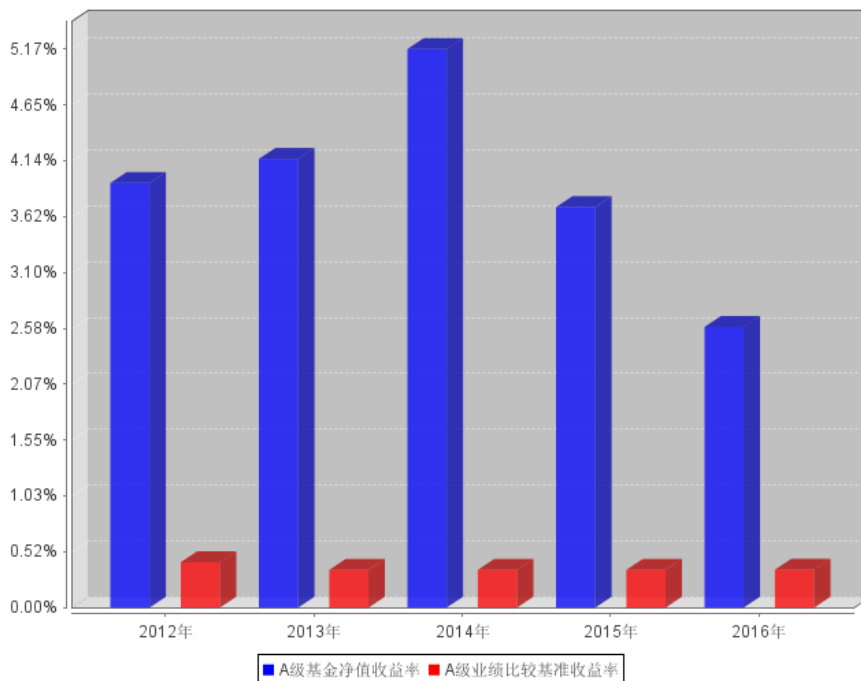
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



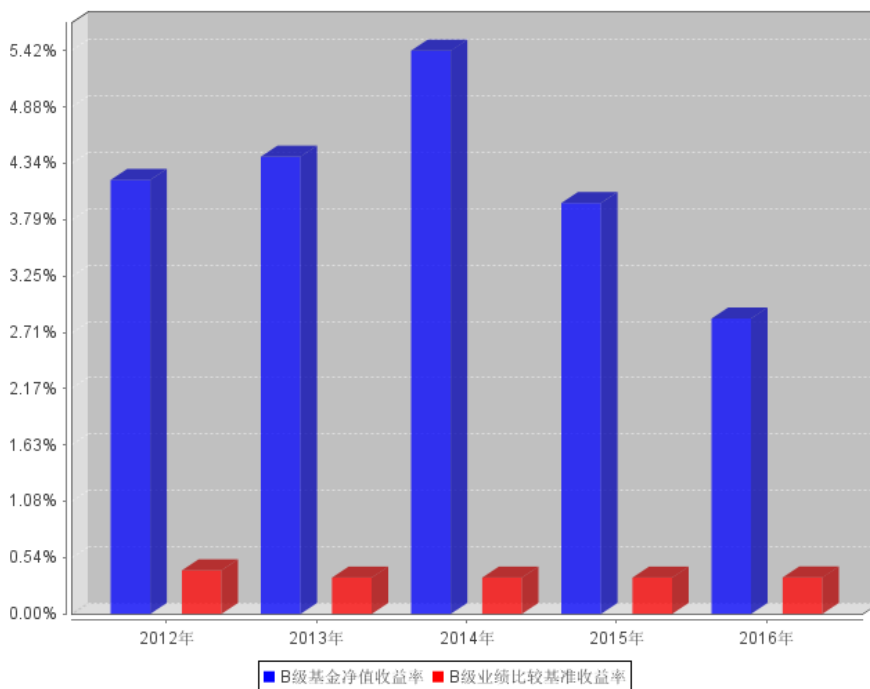
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、宝盈货币基金合同生效日为 2009 年 8 月 5 日；

2、本基金合同生效当年，基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较是按照基金合同生效当年实际存续期计算，不按照整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

宝盈货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	93,060,008.46	-	303,878.86	93,363,887.32	
2015	151,270,055.12	-	-84,505.72	151,185,549.40	
2014	77,375,914.95	-	205,886.81	77,581,801.76	
合计	321,705,978.53	-	425,259.95	322,131,238.48	

单位：人民币元

宝盈货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	651,625,672.16	-	881,696.39	652,507,368.55	
2015	698,880,166.09	-	1,155,400.10	700,035,566.19	
2014	487,743,009.26	-	-172,192.93	487,570,816.33	
合计	1,838,248,847.51	-	1,864,903.56	1,840,113,751.07	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合二十二只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理

具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2009年8月5日	-	13年	陈若劲女士，香港中文大学金融 MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作，2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
邱骏	本基金基金经理	2015年7月8日	-	6年	2010年7月加入宝盈基金管理有限公司，在固定收益部任职固定收益研究员，负责利率债、信用债、可转债等各类固定收益证券研究。

注：1、陈若劲为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、邱骏为非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2016 年 12 月 31 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信

用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，受益于前期持续宽松的货币政策和财政刺激措施，叠加供给侧改革因素，大宗商

品价格大幅上涨改善上游企业盈利，宏观经济整体逐步显现企稳态势。受制于人民币贬值压力、通胀反弹和房地产价格快速上涨，报告期内央行收紧货币政策宽松力度，政策基调趋于中性稳健，报告期内仅下调一次存款准备金率，并主要通过公开市场操作投放资金，并未采取包括降息在内的更大力度的宽松措施。

报告期内，随着央行逐步收紧货币政策宽松力度，减少公开市场资金净投放，市场资金利率中枢稳步攀升，并在年末创下全年最高水平，资金紧张程度甚至接近于 2013 年的“钱荒”时期。报告期内，商业银行对协议存款的需求呈现前低后高态势，尤其是下半年随着同业监管加强和资产负债期限错配问题日益突出，商业银行对协议存款和同业存单需求迫切，持续大幅提高存款利率。报告期内，前三季度，在资金利率难以下行、政策宽松预期、信用风险频现等多重利空利多因素共同作用下，债券市场收益率基本在低位区间窄幅震荡，10 年国开债收益率运行在 3%-3.5%，1 年 AAA 信用债收益率运行在 2.6%-3.1%；三季度后，随着资金面大幅趋紧以及监管部门一系列去杠杆措施，债券市场收益率快速大幅上行，绝对收益水平创下近年来新高，上行速度和幅度甚至超过 2013 年“钱荒”时期水平。

报告期内，随着资金利率中枢持续上行，以及债券市场信用风险频发、去杠杆监管措施逐步加强，我们整体维持了较低久期和较高评级的债券投资组合，并在部分市场资金面紧张时期参与债券波段投资机会以及配置收益率较高的协议存款和同业存单。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

货币 A:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 2.5975%，业绩比较基准收益率为 0.3510%。

货币 B:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 2.8442%，业绩比较基准收益率为 0.3510%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为受益于前期宽松的货币政策、力度不断加大的财政刺激措施以及供给侧改革因素，宏观经济短期仍将呈现逐步企稳态势。但随着货币政策宽松力度收紧、房地产调控措施加强，在缺乏明显经济增长新动力情况下，宏观经济增长或将在下半年逐步显现压力。

货币市场方面，出于防控资产泡沫、降低金融杠杆、统一资管监管需要，我们预计货币政策仍将保持中性偏紧基调，央行将灵活运用公开市场量价操作维持市场流动性，资金利率易上难下。债券市场方面，在偏紧的政策操作和市场资金面情况下，我们预计上半年市场收益率或将整体运

行在较高水平，缺乏明显投资机会，下半年随着经济基本面走弱、监管政策逐步达到目标，或将迎来较好的投资时机。

2017 年，我们将密切跟踪监管政策动向、通胀和经济数据环比变化以及市场流动性走向，耐心等待市场收益率调整到位，择机参与高评级信用债以及高收益协议存款和同业存单的配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组，由权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；量化投资部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金运营部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 A 类 93,363,887.32 元，B 类 652,507,368.55 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20380 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,609,436,972.98	10,610,742,982.86
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	8,646,147,448.03	20,521,619,816.93

其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,646,147,448.03	20,521,619,816.93
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	4,069,515,904.26	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	92,343,066.73	319,385,786.13
应收股利	-	-
应收申购款	349,459.58	8,048,991.73
递延所得税资产	-	-
其他资产	737,173.35	988,392.99
资产总计	17,418,530,024.93	31,460,785,970.64
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	3,136,894,003.55
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	727,809.87	10,981,127.87
应付管理人报酬	3,454,126.13	7,809,429.96
应付托管费	1,046,704.87	2,366,493.96
应付销售服务费	831,760.01	941,802.69
应付交易费用	308,405.67	1,792,855.99
应交税费	-	-
应付利息	-	636,328.00

应付利润	3,137,216.20	1,951,640.95
递延所得税负债	-	-
其他负债	323,284.92	343,508.22
负债合计	9,829,307.67	3,163,717,191.19
所有者权益：		
实收基金	17,408,700,717.26	28,297,068,779.45
未分配利润	-	-
所有者权益合计	17,408,700,717.26	28,297,068,779.45
负债和所有者权益总计	17,418,530,024.93	31,460,785,970.64

注：报告期截止日 2016 年 12 月 31 日，宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,121,511,397.92 份。宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 14,287,189,319.34 份。宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金和宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金的合计份额总数 17,408,700,717.26 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	945,888,232.58	1,041,246,987.33
1. 利息收入	768,181,280.40	733,348,162.71
其中：存款利息收入	308,306,647.90	203,709,150.66
债券利息收入	446,147,190.49	491,220,078.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,727,442.01	38,418,933.31
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	177,706,754.38	307,898,824.62
其中：股票投资收益	-	-

基金投资收益	-	-
债券投资收益	177,706,754.38	307,898,824.62
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	197.80	-
减：二、费用	200,016,976.71	190,025,871.74
1. 管理人报酬	89,237,116.67	83,640,914.80
2. 托管费	27,041,550.40	25,345,731.84
3. 销售服务费	11,464,614.95	12,742,812.83
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	71,895,813.94	67,927,797.77
其中：卖出回购金融资产支出	71,895,813.94	67,927,797.77
6. 其他费用	377,880.75	368,614.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	745,871,255.87	851,221,115.59
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	745,871,255.87	851,221,115.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益 (基金净值)	28,297,068,779.45	-	28,297,068,779.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	745,871,255.87	745,871,255.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-10,888,368,062.19	-	-10,888,368,062.19
其中：1. 基金申购款	156,399,068,526.66	-	156,399,068,526.66
2. 基金赎回款	-167,287,436,588.85	-	-167,287,436,588.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-745,871,255.87	-745,871,255.87
五、期末所有者权益 (基金净值)	17,408,700,717.26	-	17,408,700,717.26
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	8,838,832,902.45	-	8,838,832,902.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	851,221,115.59	851,221,115.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	19,458,235,877.00	-	19,458,235,877.00

其中：1. 基金申购款	236,851,737,006.05	-	236,851,737,006.05
2. 基金赎回款	-217,393,501,129.05	-	-217,393,501,129.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-851,221,115.59	-851,221,115.59
五、期末所有者权益（基金净值）	28,297,068,779.45	-	28,297,068,779.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

李文众 胡坤 何瑜
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收

入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	89,237,116.67	83,640,914.80
其中：支付销售机构的客户维护费	8,383,850.36	7,306,459.80

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,041,550.40	25,345,731.84

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

7.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	1,124,981.02	56,678.39	1,181,659.41
宝盈基金管理有限公司	1,019,659.87	2,148,534.23	3,168,194.10
合计	2,144,640.89	2,205,212.62	4,349,853.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	2,733,304.16	101,525.19	2,834,829.35
宝盈基金管理有限公司	1,040,817.67	1,897,739.58	2,938,557.25
合计	3,774,121.83	1,999,264.77	5,773,386.60

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金资产净值 0.25% 的年费率以及 B 类基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金管理有限公司，再由宝盈基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 A 类基金资产净值 X 0.25 % / 当年天数。

日销售服务费=前一日 B 类基金资产净值 X 0.01 % / 当年天数。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	7,056,760,865.42	4,933,572,360.43	-	-	23,279,950,000.00	2,444,716.45
上年度可比期间						
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	2,900,923,209.59	1,164,536,505.26	-	-	24,968,160,000.00	3,084,210.78

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期初持有的基金份额	-	15,322,691.72
期间申购/买入总份额	-	71,532,403.58
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	13,000,000.00
期末持有的基金份额	-	73,855,095.30
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.5200%

项目	上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期初持有的基金份额	-	44,114,604.97
期间申购/买入总份额	-	1,208,086.75
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	30,000,000.00
期末持有的基金份额	-	15,322,691.72
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.0600%

注：1、 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2、基金管理人宝盈基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托第一创业证券有限责任公司办理，适用费率为 0%。

7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,436,972.98	248,522.77	10,742,982.86	178,565.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.6 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	8,646,147,448.03	49.64
	其中：债券	8,646,147,448.03	49.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,069,515,904.26	23.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,609,436,972.98	26.46
4	其他各项资产	93,429,699.66	0.54
5	合计	17,418,530,024.93	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	12.63

	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2016 年 11 月 22 日	22.53	大额赎回	2 个工作日
2	2016 年 11 月 23 日	21.64	大额赎回	2 个工作日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	36
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

根据本基金《基金合同》中关于投资组合限制的约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”；且本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	64.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.73	-
2	30 天(含)—60 天	12.41	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	13.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	0.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.52	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,055,110,319.17	11.81
	其中：政策性金融债	2,055,110,319.17	11.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,514,799,258.57	25.93
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,076,237,870.29	11.93
8	其他	-	-
9	合计	8,646,147,448.03	49.68
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	301,652,917.61	1.73

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	160201	16 国开 01	8,000,000	799,949,701.49	4.60
2	011699713	16 中电投 SCP003	5,300,000	530,551,093.29	3.05
3	011699685	16 中建材 SCP004	4,000,000	400,454,774.12	2.30
4	160414	16 农发 14	3,000,000	299,407,239.32	1.72
5	111697991	16 苏州银行 CD122	3,000,000	297,878,227.20	1.71
6	111698273	16 重庆农村商行 CD119	3,000,000	297,554,941.10	1.71
7	011699649	16 华能 SCP005	2,800,000	280,254,232.75	1.61
8	070209	07 国开 09	2,800,000	279,688,822.38	1.61
9	011698100	16 苏交通 SCP009	2,200,000	220,071,479.83	1.26
10	011699696	16 新兴际华 SCP003	2,100,000	210,603,533.90	1.21

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	1
报告期内偏离度的最高值	0.2504%
报告期内偏离度的最低值	-0.2009%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1082%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期末无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金估值采用“摊余成本法”计价，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

8.9.2 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	92,343,066.73
4	应收申购款	349,459.58
5	其他应收款	737,173.35
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	93,429,699.66

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈货币 A	382,368	8,163.63	81,136,258.81	2.60%	3,040,375,139.11	97.40%
宝盈货币 B	252	56,695,195.71	13,778,441,166.64	96.44%	508,748,152.70	3.56%
合计	382,620	45,498.67	13,859,577,425.45	79.61%	3,549,123,291.81	20.39%

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈货币 A	19,792,312.17	0.6341%
	宝盈货币 B	-	-
	合计	19,792,312.17	0.1137%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈货币 A	>100
	宝盈货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈货币 A	>100
	宝盈货币 B	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金合同生效日（2009年8月5日）基金份额总额	428,312,282.49	1,026,847,982.99
本报告期期初基金份额总额	3,559,341,762.13	24,737,727,017.32
本报告期基金总申购份额	22,234,657,816.80	134,164,410,709.86
减：本报告期基金总赎回份额	22,672,488,181.01	144,614,948,407.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”	-	-

“填列）		
本报告期末基金份额总额	3,121,511,397.92	14,287,189,319.34

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 2016 年 4 月 27 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十一临时会议，同意储诚忠辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(2) 2016 年 8 月 4 日，宝盈基金管理有限公司第四届董事会第二十二次临时会议，同意杨凯辞去副总经理职务。本基金管理人已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局以及中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(3) 2016 年 12 月 3 日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，葛俊杰先生任宝盈基金管理有限公司副总经理。该变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备。

(4) 2016 年 9 月 27 日，宝盈基金管理有限公司董事马宏变更为张栋，本基金管理人已按规定报中国证监会备案。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 160,000 元，目前事务所已连续 8 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会《关于对宝盈基金管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停办理公募基金产品注册申请 3 个月，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，针对性的制定、实施整改措施，并向中国证监会及深圳证监局提交整改报告，深圳证监局已完成现场整改验收。

除上述情况外，报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
联合证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询
服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- (1) 租用交易单元情况

本报告期内未租用交易单元。

(2) 退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

宝盈基金管理有限公司

2017 年 3 月 27 日